

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR sorozat



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% EURIBOR 1M
ISIN kód:	HU0000714548
Indulás:	2016.05.23
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	2 610 741 462 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 755 780 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,010568 EUR

BEFKETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megcélózva ezzel a kockázatmentes hozam meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. A Részalap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő a fundamentális elemzések mellett kiemelt figyelmet fordít a piaci hangulat ingadozására, és a technikai elemzés eszközeit is használja a piacra lépés időzítésekor. A potenciális befektetési terület elsősorban, de nem kizárólag a közép-kelet európai kötvénypiac és annak derivatív piaci. A Részalap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitiek és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, hosszú (vételi) és fedezetlen rövid (eladási) pozíciókat is felvehet, de a teljes nettósított kockázati kitétsége nem haladhatja meg a 78/2014. (III. 14.) Kom. rendelet szerinti korrekció nélkül számított értéken figyelembe vett nettó eszközérték nyolcszorosát. Az "A" és "I" (forintos) sorozatok referenciahozama a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozaté az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

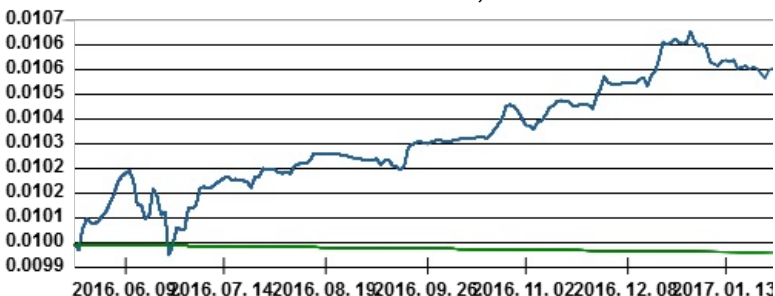
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	5,68 %	-0,26 %
1 hónap	-0,79 %	-0,03 %
3 hónap	1,55 %	-0,09 %
6 hónap	3,17 %	-0,19 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.05.23 - 2017.01.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR sorozat

— Benchmark

A múltbeli hozamok nem jelentenek garanciát az alap jövőbeli teljesítményére nézve. Jelen hirdetés nem minősül ajánlattételnek vagy befektetési tanácsadásnak. A befektetés részletes feltételeit az Alap Tájékoztatója tartalmazza, mely a mindenkor érvényes kondíciós listákkal együtt megtalálható a forgalmazási helyeken. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az év első hónapjában a piaci volatilitás meglehetősen alacsony volt. A részvényindexek a fejlett piacokon egy szűkebb sávban mozogtak, míg a kötvénypiacok inkább egy óvatos oldalazással folytatták pályájukat. A devizapiacokon a dollár egy korrekcióval gyengülni kezdett az euróval szemben, megérintve az 1,08-as szintet. A forint nyugodt, pár forintos sávban mozgott. A hazai kötvénypiac nem adott sok lehetőséget a kereskedésre, a hozamgörbe alakja meredekebb lett, erre a mozgásra lehetett pozíciókat felépíteni, melyek az elkövetkező időszakban pozitív teljesítményt nyújthatnak az alapnak.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.01.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	43,98 %
Kincstárjegyek	29,41 %
Számlapénz	26,27 %
Követelés	0,32 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,02 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

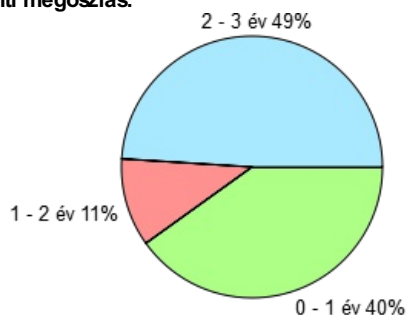
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

- 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- D170322 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

- 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,27 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

BEFKETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes **jelentős** magas nagyon magas